

●資金需給

単位：億円	2026年9月29日 需給速報	2026年9月30日 需給予想	2026年10月1日 当社予想
銀行券	700	1,000	▲ 1,300
財政	▲ 10,800	▲ 5,000	▲ 25,000
資金過不足	▲ 10,100	▲ 4,000	▲ 26,300
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出	スタート	エンド	スタート
全店共通		8,000	▲ 8,000
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入			
国債買入	4,500		
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入	▲ 100		
気候変動対応オペ			
国債補完供給	▲ 200	400	200
※ドル資金供給用担保国債供給			
当預増減	▲ 5,500	▲ 3,800	▲ 26,300
当座預金残高	4,174,300	4,170,500	4,144,200
準備預金残高	3,863,000		
積み終了先	3,862,900	9月30日以降の残り所要積立額	
超過準備	3,862,100	積数	1,100
非準備預金先	311,300	1日平均	100
積み期間（9/16～10/15日）の所要準備額（積数）			4,028,000
準備預金進捗率	実績	99.97%	日数
			46.67%

●2026年9月29日の市場動向

＜無担保コール市場＞
本日の無担保コールO/N物は、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られたことで、出合いの水準は1.225～1.228%程度で推移した。ターム物では、幅広い期間での引き合いが見受けられた。

＜レポ市場＞
GC T/Nは、1.255%程度の出合いとなった。
SCは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

＜短国市場＞
29日のアウトライト市場は、6M物と1Y物で出合いが見られた。

＜CP市場＞
CP発行市場は、複数の発行が観測された。
発行レートは、概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

9/29	無担保コール（速報）							短国		東京レポレート		JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
単位：%	最低	最高	平均		最低	最高	平均	売買参考統計値		平均値		直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時
O/N	1.200	1.229	1.227	1W	1.200	1.288	1.252		T+0	1.248		3.085	0.000	65,481.27	▲ 396.35	157.36~38	157.37~39
T/N				2W	1.228	1.350	1.248		T+1	1.250							
S/N				3W													
2日				1M	1.290	1.380	1.344		1W	1.250							
3日				2M					2W	1.250							
4日				3M					3W	1.250							
5日				4M					1M	1.251							
6日				5M					3M	1.260							
有担保コール（速報）				6M				6M	1.405		6M	1.418					
翌日物			1.180	1Y				1Y	1.650		1Y	1.615					
日付																	
日銀当預残				9/17		9/18		9/24		9/25		9/28					
準備預金残				4,102,700		4,103,000		4,182,100		4,176,400		4,179,800					
マネタリーベース				3,802,800		3,809,000		3,873,200		3,873,200		3,869,900					
無担O/N加重平均				5,295,200		5,296,600		5,375,000		5,367,300		5,369,800					
コール市場残高				0.977%		0.977%		1.227%		1.227%		1.227%					
うち無担				131,250		132,180		130,175		136,883		135,310					
うちO/N				107,403		106,150		103,048		113,507		113,002					
うち有担				43,916		44,254		45,888		52,322		53,807					
				23,847		26,030		27,127		23,376		22,308					

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入決定額(億円)	募入最低価格	募入最高利回り・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回り・利回較差	第1非償額額争入札(億円)	非償争入札(億円)
40年利付国債	19	3.8%	3,000	2026/9/30	2066/3/20	9,280	2,997	93.69	4.125%	42.4153%				

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率(%)	利回り(%)※1	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
米ドル資金供給		2026/10/1	2026/10/8	4.130		0	0				
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2026/9/29	2026/9/30		0.800	157	157		0.800	0.800	
共通担保資金供給(全店)＜変動金利方式＞	8,000	2026/9/30	2026/10/14	1.250		20,000	8,000				40.0
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2026/9/29	2026/9/30		0.800	75	75		0.800	0.800	

●2026年9月30日の予定

*8月の鉱工業生産速報値(経済産業省 8:50)	*9月のユーロ圏消費者物価指数速報値 *4-6月期の英GDP改定値 *9月の米ADP雇用統計 *8月の米個人消費支出(PCEデフレーター) *4-6月期の米GDP確定値 *9月のシカゴPM景況感指数	*2年利付国債入札 (28,000億円、10/1発行)
--------------------------	--	--------------------------------

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長（登金）第526号 日本証券業協会加入